长盛动态精选证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛动态精选混合	
基金主代码	510081	
交易代码	前端:510081	后端:511081
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年5月21日	
报告期末基金份额总额	986,961,188.97份	
投资目标	本基金通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票,在承担适度风险的前提下,追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。	
投资策略	本基金投资策略上偏重选股能力的发挥,时机的选择放在次要位置。	
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的适度风险品种,在承担适度风险的前提下,获取长期稳定的收益。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	40,118,767.36
2.本期利润	142,486,945.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.1401
4.期末基金资产净值	1,041,993,767.50
5.期末基金份额净值	1.0558

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2013年9月30日。

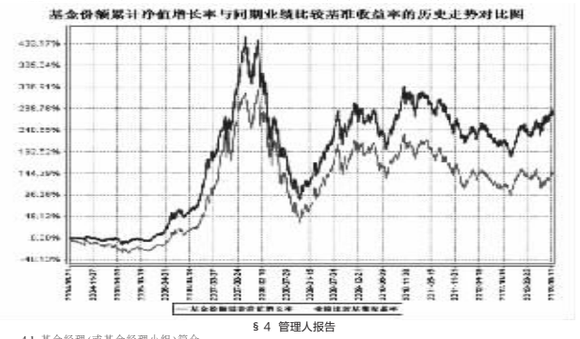
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.20%	1.24%	13.52%	1.25%	1.68%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓永明	本基金基金经理、长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2008年8月11日	-	14年	男,1971年7月出生,中国国籍,毕业于山西农业大学,获学士学位,曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理,2005年7月底加入长盛基金管理有限公司,曾任基金同益基金经理助理,同德证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任权益投资部副总监,长盛动态精选证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等,具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易价段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.0558元,本报告期份额净值增长率为15.20%,同期业绩比较基准增长率为13.52%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	818,374,008.00	78.17
	其中:股票	818,374,008.00	78.17
2	固定收益投资	110,270,000.00	10.53
	其中:债券	110,270,000.00	10.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	115,566,009.32	11.04
6	其他资产	2,706,903.76	0.26
7	合计	1,046,916,921.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	692,331,457.75	66.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,336,104.80	0.22
E	建筑业	7,810,844.80	0.75
F	批发和零售业	32,876,953.50	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,138,590.99	1.26
J	金融业	24,523,095.92	2.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	14,275,484.30	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,081,475.94	2.98
S	综合	-	-
	合计	818,374,008.00	78.54

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	1,540,971	86,787,486.72	8.33
2	600276	恒瑞医药	1,516,164	55,142,884.68	5.29
3	000581	威孚高科	2,200,893	51,919,065.87	4.98
4	000895	双汇发展	1,020,441	47,399,484.45	4.55
5	600887	伊利股份	1,000,511	44,702,831.48	4.29
6	002318	久立特材	2,104,305	42,317,573.55	4.06
7	002241	歌尔声学	500,719	21,170,399.32	2.03
8	000963	华东医药	469,065	20,591,953.50	1.98
9	300251	光线传媒	300,959	19,484,085.66	1.87
10	300115	长盈精密	514,350	19,473,291.00	1.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	50,420,000.00	4.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,850,000.00	5.74
	其中:政策性金融债	59,850,000.00	5.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	110,270,000.00	10.58

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	600,000	59,850,000.00	5.74
2	010107	21国债(7)	300,000	30,930,000.00	2.97
3	010213	02国债(13)	200,000	19,490,000.00	1.87

注:本基金本报告期末仅持有上述3只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同中约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同中约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	979,326.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,721,440.24
5	应收申购款	6,136.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,706,903.76

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,038,258,475.70
报告期期间基金总申购份额	6,879,653.85
减:报告期期间基金总赎回份额	58,176,940.58
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	986,961,188.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》;

3、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》;

4、《长盛动态精选证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2013年10月23日

长盛货币市场基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	308,868,496.69份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用,以提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1. 本期已实现收益	3,357,721.27
2.本期利润	3,357,721.27
3.期末基金资产净值	308,868,496.69

注:1、所列数据截止到2013年9月30日。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

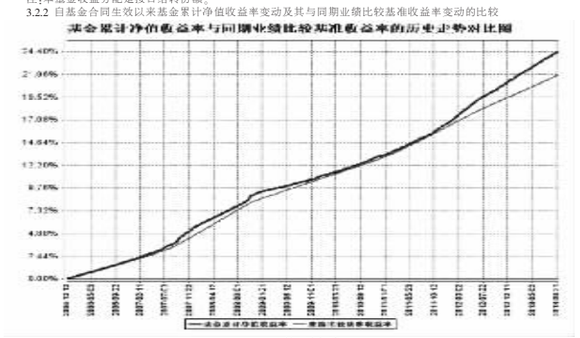
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8073%	0.0034%	0.7562%	0.0000%	0.0511%	0.0034%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾志敏	本基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、固定收益部副总监。	2013年2月7日	-	7年	男,1982年3月出生,中国国籍,北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作,2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金(本基金)基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易价段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年第三季度,通胀水平始终保持在3%以下的水平,经济弱复苏态势进一步明确两者难以对债券市场形成明显的指引作用,6月中下旬钱荒过后,央行加强了货币市场流动性管理,资金成本较上半年有所提升,债券市场在波动中走出一波熊市行情,具体来看:利率债方面,利率产品供给压力释放引发的供需失衡导致一级市场招标利率持续超出市场预期,市场悲观情绪日渐浓重,二级市场收益率逐步上行,10年期国债收益率上行50bp左右,突破了4%的敏感点位,并一度达到4.14%高点;信用债方面,短端收益率上行幅度大于长端收益率,低等级上行幅度高于高等级,收益率曲线逐渐扁平化。

货币市场方面,三季度银行间货币市场利率较上半年中枢有所上移,银行间资金面总体保持中性偏紧的态势,以银行间七天回购利率为例,该利率在三季度基本维持在4%左右。各中短期限Shibor利率维持在相对较低水平,例如SHIBOR 2W大体维持在4.44%左右。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内,在保证流动性的前提下,基金重点配置了中低等级短融等信用品种,获取了一定的债券增值收益。此外,滚动配置了同业存款,适当配置了利率品种。在经济弱复苏、通胀保持低位的情况下,基金高度重视信用风险管理,防范信用风险的发生。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年3季度,长盛货币净值收益率为0.8073%,同期业绩比较基准收益率0.7562%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	250,195,725.70	76.18
	其中:债券	250,195,725.70	76.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	72,638,798.21	22.12
4	其他资产	5,581,009.73	1.70
5	合计	328,415,533.64	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.40	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	17,999,853.00	5.83
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	135
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	33.23	5.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	6.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.99	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	38.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.52	5.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,171,133.52	16.24
	其中:政策性金融债	50,171,133.52	16.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,024,592.18	64.76
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	250,195,725.70	81.00
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	090407	09农发07	300,000	30,111,997.62	9.75
2	041364003	13沁新能源CP001	300,000	30,009,436.64	9.72
3	041359005	13广汇能源CP001	300,000	30,002,383.87	9.71
4	041359035	13前进齿轮CP001	200,000	20,012,504.31	6.48
5	041354005	13京投CP001	200,000	20,000,669.58	6.48
6	041356020	13奇瑞CP001	200,000	20,000,103.06	6.48
7	041260069	12梅花CP001	200,000	19,998,867.75	6.47
8	041359012	13沙钢CP001	200,000	19,998,021.15	6.47
9	090306	09进出06	100,000	10,056,762.97	3.26
10	130210	13国开10	100,000	10,002,372.93	3.24

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1158%
报告期内偏离度的最低值	-0.1105%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0456%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,546,521.30
4	应收申购款	-
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	7,131.68
7	其他	-
8	合计	5,581,009.73

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	542,120,850.19
报告期期间基金总申购份额	711,031,276.21
减:报告期期间基金总赎回份额	944,283,629.71
报告期期末基金份额总额	308,868,496.69

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛货币市场基金基金合同》;

3、《长盛货币市场基金托管协议》;

4、《长盛货币市场基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2013年10月23日

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同鑫二号保本混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月10日
报告期末基金份额总额	691,184,971.56份
投资目标	本基金采用投资组合保险策略(CPPI)和基于期权的组合保险策略(OBPI),其中主要通过CPPI策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例,以确保在保本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额,不享受保本担保。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,926,761.17
2.本期利润	-4,956,039.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0063
4.期末基金资产净值	710,128,509.29
5.期末基金份额净值	1.027

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2013年9月30日。

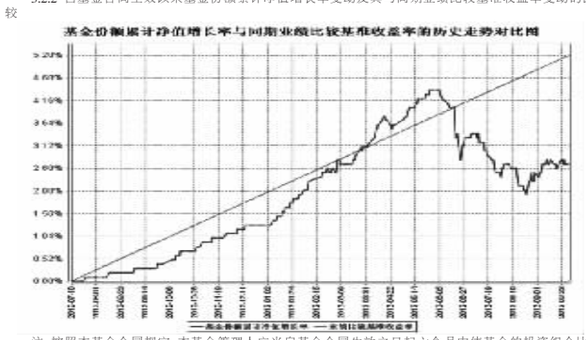
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.58%	0.10%	1.03%	0.01%	-1.61%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四部分(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡宾	本基金基金经理、长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理、社保组合经理、固定收益部总监。	2012年7月10日	-	9年	男,1978年11月出生,中国国籍,毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(美国特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理,2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理、投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同德信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务,现任固定收益部总监、社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个